

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	4,130	10	Acreedores	405,757	394,897
Bancos monedas extranjeras	26,397	24,263	Provisiones para gastos	3,462	4,269
Divisas por recibir	56,575	5,079	Divisas por entregar	57,328	-
	87,102	29,353	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,700,792	799,670
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	2,167,339	1,198,837
Inversión en valores de renta variable	11,544,939	8,197,822			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(651,330)	942,114			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	10,431,941	6,934,262			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	528,437	730,402			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	18,095,893	16,100,447			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,646,004)	(66,802)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	774,648	777,766			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(136,089)	83,162			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,619,070	394,584			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(838)	27,220			
Inversión en FIBRAS	1,166,711	959,110			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(168,438)	(147,381)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	20,166	2,016			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,190	8			
Inversión en valores extranjeros de deuda	174,376	34,621			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(8,392)	2,592			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,108,720	2,663,934			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	438,517	(44,536)			
Valores Prestados	-	153,879			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	2,572			
Inversión en Fondos Mutuos	2,313,387	2,281,314			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(309,957)	200,483			
	48,296,950	40,229,590			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	48,616	71,997			
Div dendos o derechos por cobrar	27	491			
Intereses devengados sobre valores	316,666	253,628			
Reportos	2,551,401	3,305,088			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	4			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	656			
Reembolsos y otros intereses	996	567			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	459,204	632,558			
	3,376,909	4,264,991			
TOTAL ACTIVO	51,760,960	44,523,934			
			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	44,826,965	35,831,812
			Capital soc al pagado	43,950,700	36,376,443
			Prima en venta de acciones	876,265	(544,631)
			CAPITAL GANADO	6,720,749	5,763,458
			Resultados de ejercicios anteriores	7,730,812	2,800,827
			Resultados del ejercicio	(1,010,063)	2,962,632
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,954,094)	1,729,826
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	49,593,621	43,325,097
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	51,760,960	44,523,934

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	48,121,994	39,924,314	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	156,451	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	160,591	Acciones en circulación, posición propia	19,733,687	18,265,566
Colaterales recibidos por reportos	2,552,522	3,302,098	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	10,473	160,397	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	3,534,276,002	2,923,262,807
Bancos divisas en moneda extranjera	1,354	1,219			
Dólares americanos	1,154	1,219			
Otras Divisas	201	-			
Divisas por recibir	2,810	255			
Dólares americanos	2,810	255			
Divisas por entregar	2,847	-			
Dólares americanos	2,847	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,031,217	2,454,468			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	37,015,672	36,844,992			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	12,499,195	9,595,606			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,850,636	2,933,605			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,110,028	3,071,235			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	892,458	999,688			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	116,757			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,282,356	6,970,649			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,042,870	3,488,129			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	336,393	542,819			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	5,612,125	4,288,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	340,176	4,748,758			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	494	40,682			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	24,630,480	27,124,346			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	501,297			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,886,951	3,217,934			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,072,791	2,455,739			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	814,471	703,263			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,002,550	3,678,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	840,874	5,249,456			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	141,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,034,814	6,816,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,163,786	3,609,045			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,954,094	\$	1,729,826
Un valor de los activos netos de:	\$	49,593,621	\$	43,325,097
El precio de la acción de:	\$	13.954273	\$	14.728771

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	7,513,761	10,551,198
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,380,869	1,003,142
Resultado cambiario / Otros productos	(13,059)	(12,893)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(2,546,273)	1,059,319
INGRESOS NETOS	6,335,297	12,600,766
Costo de ventas de valores	7,196,332	9,460,665
Gastos generales	6,237	7,052
Comisiones sobre saldos	137,185	164,568
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,607	5,850
EGRESOS NETOS	7,345,361	9,638,135
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,010,063)	2,962,632
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,690,728)	(1,292,997)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(4,700,792)	1,669,635

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.